

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	信託期間は2003年1月15日から無期限です。	
運用方針	確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく確定拠出年金専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	DC外国債券インデックスファンドL	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	DC外国債券インデックスファンドL	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限ることとし、実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	外国債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資には、制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。分配対象額は、経費控除後の利子等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の合計額とします。分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

# DC外国債券 インデックスファンドL

## 運用報告書(全体版)

第21期(決算日 2023年10月24日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

### 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ  
フリーダイヤル:0120-668001  
(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

**【本運用報告書の記載について】**

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配)			ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額 総
	円	税金 分配	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %					
第17期(2019年10月24日)	18,451	0	5.1	470.194	5.8	98.4	0.5			百万円 30,743
第18期(2020年10月26日)	19,180	0	4.0	490.934	4.4	97.5	1.5			34,356
第19期(2021年10月25日)	20,139	0	5.0	515.549	5.0	97.5	1.7			37,210
第20期(2022年10月24日)	20,376	0	1.2	525.265	1.9	98.3	0.7			39,634
第21期(2023年10月24日)	21,129	0	3.7	543.784	3.5	98.3	0.5			40,620

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率
	円	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %		
(当期首) 2022年10月24日	20,376	—	525.265	—	98.3	0.7
10月末	20,768	1.9	531.092	1.1	98.5	0.5
11月末	20,141	△1.2	516.243	△1.7	98.4	0.6
12月末	19,159	△6.0	494.385	△5.9	97.7	1.2
2023年1月末	19,381	△4.9	498.367	△5.1	97.1	1.7
2月末	19,611	△3.8	503.372	△4.2	97.8	1.2
3月末	19,855	△2.6	507.635	△3.4	98.2	0.7
4月末	19,997	△1.9	513.970	△2.2	98.4	0.6
5月末	20,510	0.7	527.860	0.5	98.3	0.5
6月末	21,324	4.7	548.017	4.3	98.0	0.9
7月末	20,861	2.4	534.743	1.8	98.1	0.8
8月末	21,426	5.2	550.428	4.8	98.2	0.6
9月末	21,105	3.6	542.874	3.4	98.2	0.6
(当期末) 2023年10月24日	21,129	3.7	543.784	3.5	98.3	0.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

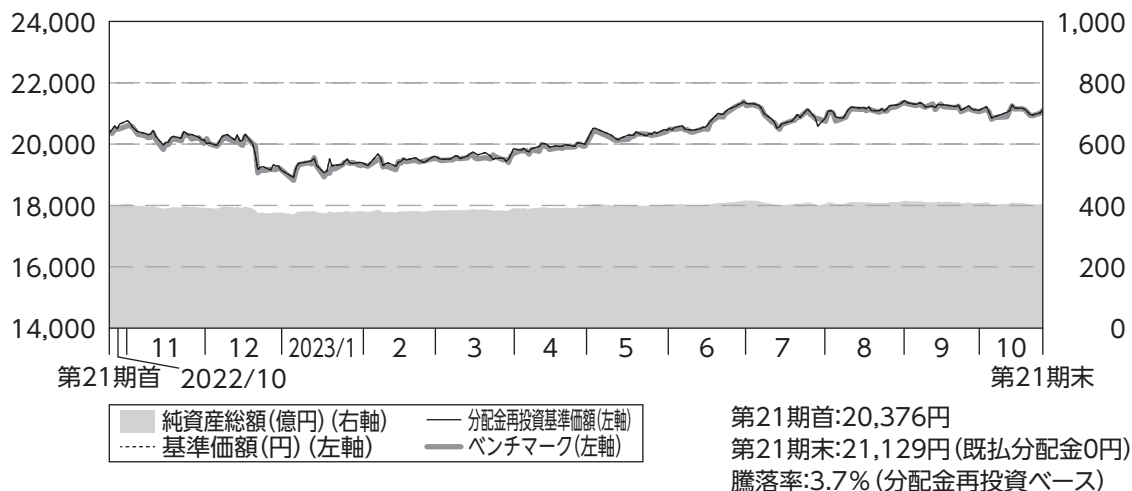
ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

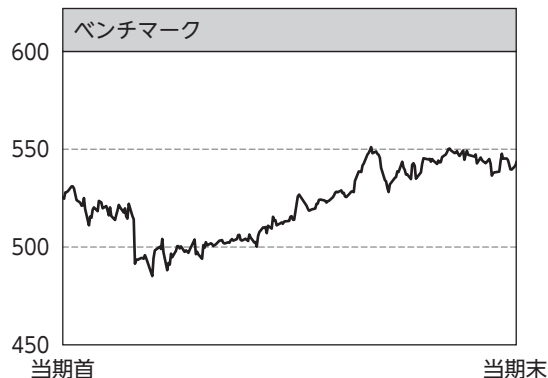
### 基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年10月24日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。



外国債券市場では、主要国の長期金利は上昇(債券価格は下落)しました。

2023年1月下旬にかけて、米国で賃金上昇率やCPI(消費者物価指数)などインフレ指標の伸び率の鈍化が続く中、FRB(米連邦準備理事会)が利上げペースを緩めるとの見方が強まったことなどから、主要国の長期金利は低下(債券価格は上昇)しました。その後は、米地銀破綻に端を発した金融不安の高まりを受けて、長期金利が一時低下する局面も見られましたが、欧米を中心にインフレ圧力抑制のための政策金利長期高止まり懸念が高まったことなどから、主要国の長期金利は上昇しました。加えて、米長期金利については、大手格付会社による米国価格下げや米財務省の定例入札による発行増額なども、その上昇を後押ししました。

外国為替市場では、主要通貨は対円で上昇しました。2023年1月下旬にかけて、本邦と主要国の金利差縮小や日銀による長期金利の変動許容幅の引き上げが事実上の金融引き締めと受け止められたことなどにより、主要通貨に対して、円高推移となりました。その後は、本邦と主要国の金利差拡大や日銀の金融正常化観測が後退したことなどにより、主要国との金融政策姿勢の違いが意識され、円安が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目的とする「外国債券マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

### 【「外国債券マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

#### (1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は、ヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

#### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

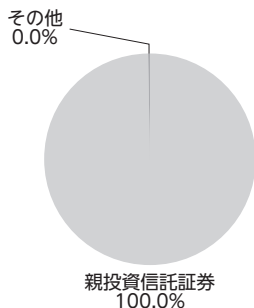
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

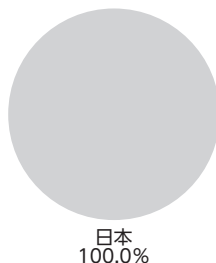
	当期末
	2023年10月24日
外国債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

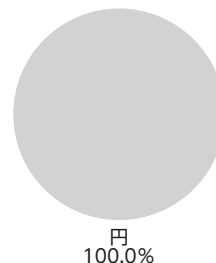
### ○資産別配分



### ○国別配分



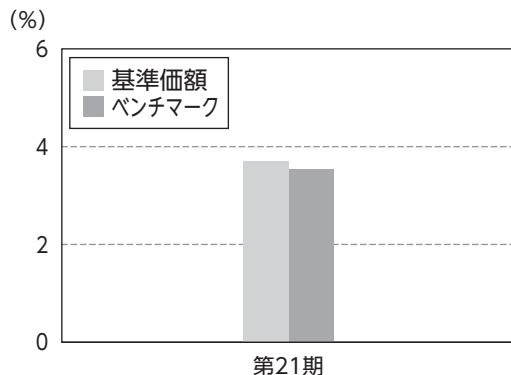
### ○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、信託報酬(マイナス要因)および為替評価差要因\*(プラス要因)です。

\*当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

## 分配金

長期的な信託財産の成長を図るため、収益分配は見送りとさせていただきます。  
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第21期	
	2022年10月25日～2023年10月24日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	12,421	

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に分散投資を行い、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年10月25日～2023年10月24日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	51円	0.253%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{[期中の平均基準価額]} \times \text{信託報酬率}}{\text{期中の平均基準価額}}$ は20,344円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(25)	(0.121)	
(販売会社)	(18)	(0.088)	
(受託会社)	(9)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}}$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	3	0.016	(d) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}}$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(3)	(0.016)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	54	0.269	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

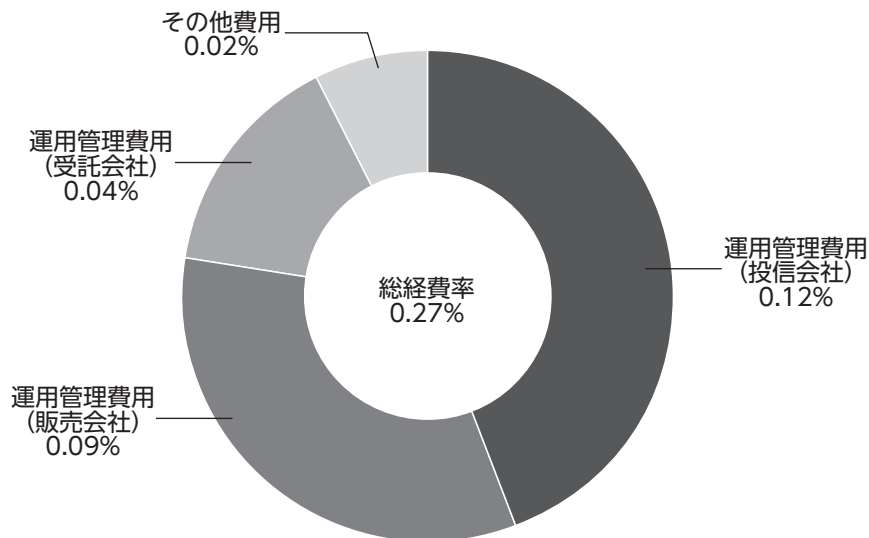
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## <参考情報>

### 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.27%です。



(注1)各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 1,025,114	千円 2,779,040	千口 1,229,410	千円 3,364,392

## 利害関係人※との取引状況等

### ■ 利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 1	百万円 1	% 100.0	百万円 1	百万円 1	% 100.0
コール・ローン	18,947	2,017	10.6	18,950	2,029	10.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <外国債券マザーファンド>

区 分	当 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 28,308	百万円 28,308	% 100.0	百万円 28,490	百万円 28,490	% 100.0
為替直物取引	13,107	13,019	99.3	7,820	7,747	99.1
金 銭 信 託	11	11	100.0	11	11	100.0
コール・ローン	314,553	33,052	10.5	314,564	33,197	10.6

<平均保有割合 25.1%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)		当 期 末	
	口 数		口 数	評 価 額
外 国 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 14,527,737		千口 14,323,441	千円 40,599,793

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、59,244,020千口です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外 国 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 40,599,793	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	108,765	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	40,708,558	100.0

(注1)外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(166,808,778千円)の投資信託財産総額(168,021,956千円)に対する比率は99.3%です。

(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=149.76円	1カナダドル=109.41円	1メキシコペソ=8.2611円
1ユーロ=159.81円	1イギリスポンド=183.53円	1スウェーデンクローナ=13.64円
1ノルウェークローネ=13.52円	1デンマーククローネ=21.41円	1ポーランドズロチ=35.8451円
1オーストラリアドル=94.95円	1ニューージーランドドル=87.64円	1シンガポールドル=109.58円
1マレーシアリンギット=31.2879円	1オフショア人民元=20.4941円	1イスラエルシェケル=36.8982円

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年10月24日現在
(A) 資 産	40,708,558,157円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	93,714,561
外国債券マザーファンド(評価額)	40,599,793,968
未 収 入 金	15,049,628
(B) 負 債	88,555,930
未 払 解 約 金	37,038,666
未 払 信 託 報 酬	51,517,215
未 払 利 息	46
そ の 他 未 払 費 用	3
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	40,620,002,227
元 本	19,224,402,505
次 期 繰 越 損 益 金	21,395,599,722
(D) 受 益 権 総 口 数	19,224,402,505口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,129円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年10月25日 至 2023年10月24日
(A) 配 当 等 収 益	△38,286円
受 取 利 息	420
支 払 利 息	△38,706
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,551,676,127
売 買 益	1,728,651,619
売 買 損	△176,975,492
(C) 信 託 報 酬 等	△100,357,271
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,451,280,570
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,569,650,991
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,374,668,161
(配 当 等 相 当 額)	(17,849,999,549)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,475,331,388)
(G) 計 (D+E+F)	21,395,599,722
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	21,395,599,722
追 加 信 託 差 損 益 金	15,374,668,161
(配 当 等 相 当 額)	(17,858,928,758)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,484,260,597)
分 配 準 備 積 立 金	6,020,931,561

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みません。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は19,450,935,657円、期中追加設定元本額は3,334,027,207円、期中一部解約元本額は3,560,560,359円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	815,765,995円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	500,919,916円
(C) 収益調整金額	17,858,928,758円
(D) 分配準備積立金額	4,704,245,650円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	23,879,860,319円
(F) 期末残存口数	19,224,402,505口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	12,421円
(H) 分配金額(1万口当たり)	—円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	—円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国債券マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2023年2月7日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2001年2月22日から無期限です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・ 基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第18期(2019年2月7日)	23,318	△1.6	447.318	△1.4	96.6	1.6	133,456
第19期(2020年2月7日)	24,866	6.6	477.531	6.8	97.4	1.3	141,275
第20期(2021年2月8日)	25,857	4.0	496.296	3.9	97.7	1.5	144,346
第21期(2022年2月7日)	26,350	1.9	505.817	1.9	97.9	1.4	150,121
第22期(2023年2月7日)	26,193	△0.6	503.924	△0.4	98.3	0.8	151,005

(注)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2022年 2月7日	26,350	—	505.817	—	97.9	1.4
2月末	25,990	△1.4	500.360	△1.1	98.0	1.0
3月末	26,854	1.9	514.015	1.6	97.9	1.2
4月末	26,904	2.1	514.167	1.7	98.1	1.0
5月末	26,739	1.5	512.002	1.2	97.8	1.2
6月末	27,381	3.9	527.332	4.3	96.9	2.0
7月末	27,578	4.7	528.619	4.5	97.9	1.3
8月末	27,246	3.4	523.319	3.5	97.7	1.2
9月末	27,001	2.5	516.025	2.0	97.7	1.3
10月末	27,793	5.5	531.092	5.0	98.6	0.5
11月末	26,960	2.3	516.243	2.1	98.4	0.6
12月末	25,650	△2.7	494.385	△2.3	97.8	1.2
2023年 1月末	25,952	△1.5	498.367	△1.5	97.2	1.7
(当期末) 2023年 2月7日	26,193	△0.6	503.924	△0.4	98.3	0.8

(注1)騰落率は期首比です。

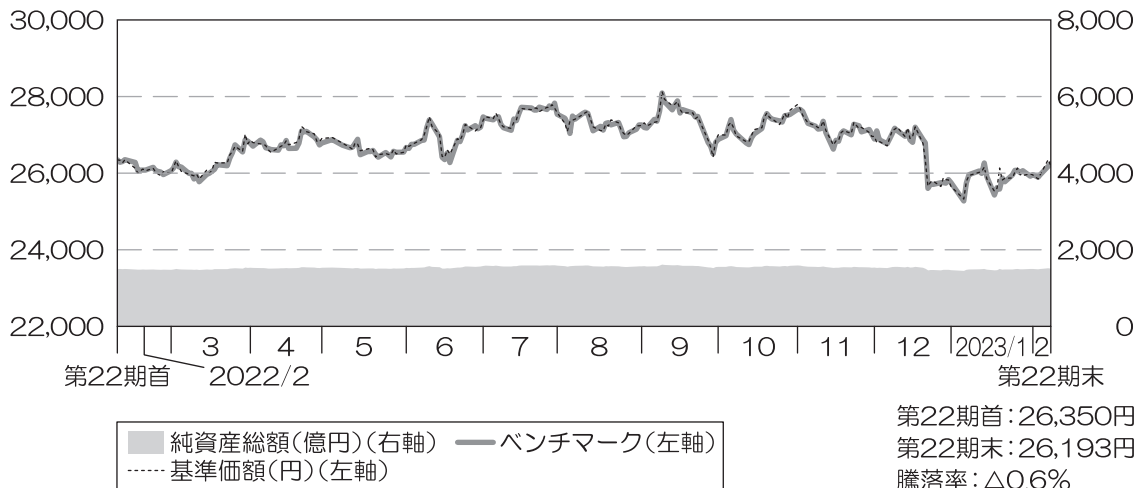
(注2)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

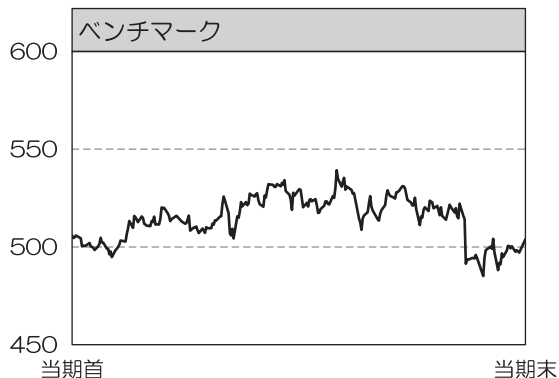


(注)ベンチマークは、2022年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

2022年7月下旬にかけて、インフレ加速から主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)推移となったものの、日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことから外国為替市場で主要通貨に対して円安が進行し、基準価額は上昇しました。8月から11月上旬にかけては、主要国の長期金利上昇と円安推移が続いたことから、基準価額は上下動を伴いながらもレンジ内推移となりました。11月中旬から12月中旬にかけて、米国でのインフレ率の上昇ピークアウト観測から主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)したものの、それまでの主要通貨に対する円安からの円買戻しの展開により、基準価額は緩やかに下落しました。12月下旬に、日銀による長期金利の変動許容幅の引き上げが事実上の利上げと受け止められて、日本と主要国の長期金利差縮小観測から急激に円高が進行し、基準価額は大幅下落となりました。2023年1月以降は、世界的にインフレ率の上昇ピークアウト観測が広がり主要国の長期金利が低下したことから、基準価額は緩やかに上昇しました。

## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2022年11月上旬にかけて、FRB(米連邦準備理事会)とECB(欧州中央銀行)が大幅利上げを連続で実施したことから、大幅に上昇推移となりました。11月中旬以降は、主要中央銀行がインフレ抑制を最優先する姿勢を明らかにした一方で、世界的にインフレ率の上昇ピークアウト観測が広がる中、先行きの景気後退リスクが意識されたことから、上昇幅を縮小しました。

外国為替市場では、2022年10月下旬にかけて、日本と欧米主要中央銀行の金融政策の違いを背景に概ね円安推移となりました。その後は、日銀による長期金利の変動許容幅の引き上げなどを材料に円買戻しの流れとなり、円は下落率を縮小しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。



当ファンドの組入資産の内容

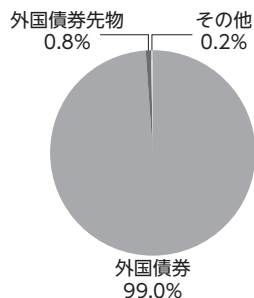
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	0.9%
2	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.9%
3	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	0.9%
4	T 2.875% 08/15/28	アメリカ	0.9%
5	CGB 1.99% 04/09/25	中国	0.8%
6	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.6%

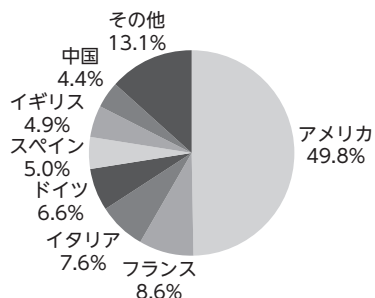
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.375% 04/30/25	アメリカ	0.6%
8	T 2.25% 03/31/24	アメリカ	0.6%
9	T 1.125% 10/31/26	アメリカ	0.6%
10	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.6%
組入銘柄数		817	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

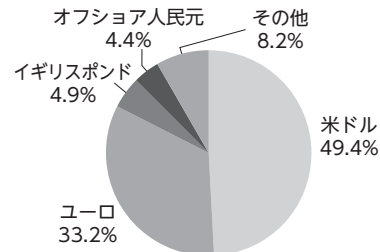
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

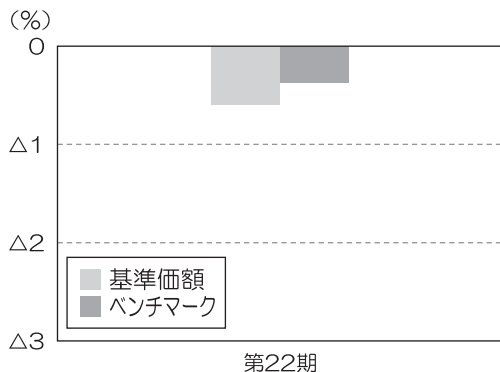


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.8%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差<sup>(※)</sup> (マイナス要因) 等です。

(※) 当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

## 今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年2月8日～2023年2月7日)		
	金額	比率	
<b>(a) 売買委託手数料</b>	<b>0円</b>	<b>0.000%</b>	$(a) \text{ 売買委託手数料} = \frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
<b>(b) 有価証券取引税</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	$(b) \text{ 有価証券取引税} = \frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
<b>(c) その他費用</b>	<b>4</b>	<b>0.015</b>	$(c) \text{ その他費用} = \frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(4)	(0.015)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
<b>合計</b>	<b>4</b>	<b>0.015</b>	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(26,837円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 135,341	千米ドル 122,382
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 9,152	千カナダドル 7,955
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 27,400	千メキシコペソ 29,576
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 16,216	千ユーロ 16,709
	イ タ リ ア	国 債 証 券	11,294	15,623
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	9,407	13,020
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	1,914	3,007
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	8,149	10,649
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	1,922	2,609
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	1,887	2,254
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	690	897
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	257	947
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 9,987	千イギリスポンド 6,711
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 187	千スウェーデンクローナ 7,454
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 2,109	千ノルウェークローネ 5,891
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 2,070	千デンマーククローネ 6,479
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 2,929	千ポーランドズロチ 3,191
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 2,651	千オーストラリアドル 1,561
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ニュージーランドドル 3,885	千ニュージーランドドル -
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 1,076	千シンガポールドル 1,327
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 3,462	千マレーシアリンギット 3,238
	中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 274,817	千オフショア人民元 14,736
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 1,412	千イスラエルシェケル 3,978

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 16,248	百万円 17,166	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
		B A	%		D C	%
為 替 先 物 取 引	百万円 31,706	百万円 31,706	100.0	百万円 32,631	百万円 32,631	100.0
為 替 直 物 取 引	10,172	10,117	99.5	7,660	7,579	98.9
金 銭 信 託	0.066643	0.066643	100.0	0.066643	0.066643	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	434,046	34,427	7.9	434,591	34,250	7.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## 組入資産の明細

### <外国(外貨建)公社債> (A)債券種類別開示

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち80%以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	624,860	558,113	73,994,656	49.0	—	21.7	17.7	9.6
カ ナ ダ	33,840	31,361	3,095,074	2.0	—	1.1	0.6	0.4
メ キ シ コ	186,730	179,431	1,241,668	0.8	—	0.4	0.2	0.2
ド イ ツ	72,470	68,456	9,739,278	6.4	—	3.5	2.0	0.9
イ タ リ ア	84,810	79,078	11,250,475	7.5	—	4.2	2.2	1.1
フ ラ ン ス	96,210	89,190	12,689,179	8.4	—	5.1	2.5	0.8
オ ラ ン ダ	17,280	15,948	2,269,022	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ス ペ イ ン	55,400	52,485	7,467,146	4.9	—	2.9	1.5	0.6
ペ ル ギ ー	20,990	19,535	2,779,255	1.8	—	1.3	0.4	0.1
オ ー ス ト リ ア	13,950	12,536	1,783,550	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	6,150	5,325	757,663	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ア イ ル ラ ン ド	7,570	6,751	960,572	0.6	—	0.4	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 51,870	千イギリスポンド 45,756	7,300,938	4.8	—	3.4	0.9	0.5
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 24,170	千スウェーデンクローナ 23,659	295,743	0.2	—	0.1	0.1	—
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 24,170	千ノルウェークローネ 22,876	293,505	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 26,930	千デンマーククローネ 25,783	492,974	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 25,670	千ポーランドズロチ 22,479	674,227	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 28,540	千オーストラリアドル 26,427	2,415,251	1.6	—	1.1	0.4	0.1
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	千ニューージーランドドル 4,400	千ニューージーランドドル 3,971	332,451	0.2	—	0.1	0.1	0.0
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 7,100	千シンガポールドル 6,898	689,334	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 26,600	千マレーシアリンギット 27,382	842,433	0.6	—	0.3	0.2	0.0
中 国 オ フ シ ョ ア	千オフショア人民元 330,690	千オフショア人民元 332,736	6,490,923	4.3	—	2.0	1.8	0.5
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシケル 13,820	千イスラエルシケル 13,524	516,250	0.3	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	148,371,579	98.3	—	50.5	32.2	15.5

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

















銘柄	利率	当 期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット			
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	560	565	17,386	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,110	1,057	32,545	2040/5/22	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	250	246	7,598	2034/7/5	
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	860	856	26,355	2033/4/15	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	690	697	21,458	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,890	1,908	58,701	2029/8/15	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	300	304	9,371	2027/3/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,960	1,998	61,478	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,140	1,157	35,612	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	750	761	23,420	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,100	1,115	34,321	2025/9/15	
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,060	1,074	33,054	2024/9/30	
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	740	709	21,838	2050/6/15	
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,180	1,196	36,797	2024/7/15	
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	850	876	26,954	2031/6/30	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,480	1,520	46,780	2035/5/31	
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,160	1,193	36,723	2026/4/15	
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,260	1,318	40,578	2030/4/15	
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,160	1,232	37,919	2033/11/7	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	900	96	2,978	2042/10/15	
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	640	687	21,149	2046/3/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	1,160	1,245	38,326	2037/4/7	
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	1,490	1,641	50,495	2038/6/8	
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,450	1,590	48,931	2048/7/6	
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	820	903	27,799	2043/9/30	
小 計				842,433		
(中国オフショア) 国債証券		千オフショア 人民元	千オフショア 人民元			
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	63,260	62,652	1,222,212	2025/4/9	
CGB 2.28% 03/17/24	2.28	5,100	5,102	99,535	2024/3/17	
CGB 2.47% 09/02/24	2.47	18,290	18,324	357,461	2024/9/2	
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	18,380	18,229	355,606	2027/4/15	
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	7,750	7,557	147,428	2032/9/1	
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	21,000	20,709	404,001	2029/9/25	
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	11,650	11,495	224,244	2030/5/21	
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	11,720	11,754	229,296	2026/8/12	
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	4,000	3,930	76,674	2032/8/15	
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	15,770	15,759	307,439	2029/3/24	
CGB 2.84% 04/08/24	2.84	16,020	16,141	314,890	2024/4/8	
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	11,760	11,836	230,903	2027/6/4	
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	22,500	22,508	439,096	2031/11/18	
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	14,300	14,426	281,429	2028/10/14	
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	7,960	8,069	157,425	2028/5/13	
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	7,400	7,490	146,123	2031/5/27	
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	22,150	22,499	438,910	2026/3/11	
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	2,500	2,423	47,282	2052/10/25	
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	3,430	3,552	69,292	2030/11/19	

銘柄	利率	当 期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千オフショア 人民元	千オフショア 人民元			
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	11,140	11,487	224,089	2027/12/3	
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	3,020	3,039	59,294	2052/4/15	
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	5,360	5,433	106,004	2050/3/16	
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	7,010	7,286	142,139	2051/10/18	
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	3,150	3,380	65,941	2051/4/12	
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	8,230	8,966	174,907	2050/9/14	
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	5,810	6,371	124,288	2049/7/22	
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	2,030	2,306	45,001	2048/10/22	
小 計				6,490,923		
(イスラエル) 国債証券		千イスラエ ルシェケル	千イスラエ ルシェケル			
ILGOV 0.4% 10/31/24	0.4	750	708	27,049	2024/10/31	
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	350	321	12,261	2026/2/27	
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	720	672	25,688	2025/4/30	
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	1,570	1,344	51,311	2030/3/31	
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	310	262	10,005	2032/4/30	
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	930	733	27,990	2037/5/31	
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,040	992	37,894	2025/8/31	
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	1,210	1,144	43,669	2027/3/31	
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	1,070	1,015	38,754	2028/9/28	
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	260	222	8,498	2052/11/29	
ILGOV 3.75% 03/31/24	3.75	1,560	1,558	59,492	2024/3/31	
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	1,440	1,494	57,042	2047/3/31	
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,060	1,356	51,783	2042/1/31	
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,550	1,697	64,808	2026/10/30	
小 計				516,250		
合 計				148,371,579		

(注) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外		
EURO-SCHATZ	105	—
US 5YR NOTE	244	—
EURO-BOBL FU	166	—
EURO-BUND	292	—
国		
US 10YR NOTE	195	—
US LONG BOND	205	—

(注) 外貨建の評価額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 148,371,579	98.2%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,731,601	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	151,103,180	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(149,659,006千円)の投資信託財産総額(151,103,180千円)に対する比率は99.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=132.58円	1カナダドル=98.69円	1メキシコペソ=6.92円
1ユーロ=142.27円	1イギリスポンド=159.56円	1スウェーデンクローナ=12.50円
1ノルウェークローネ=12.83円	1デンマーククローネ=19.12円	1ポーランドズロチ=29.9924円
1オーストラリアドル=91.39円	1ニュージーランドドル=83.70円	1シンガポールドル=99.92円
1マレーシアリンギット=30.765円	1オフショア人民元=19.5077円	1イスラエルシェケル=38.1706円

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年2月7日現在
(A) 資 産	152,358,547,210円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,441,885,610
公 社 債(評価額)	148,371,579,304
未 収 入 金	1,290,898,972
未 収 利 息	1,061,074,568
前 払 費 用	76,309,757
差 入 委 託 証 拠 金	116,798,999
(B) 負 債	1,352,660,393
未 払 金	1,276,970,551
未 払 解 約 金	75,688,185
未 払 利 息	1,657
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	151,005,886,817
元 本	57,650,368,316
次 期 繰 越 損 益 金	93,355,518,501
(D) 受 益 権 総 口 数	57,650,368,316口
1万口当たり基準価額(C/D)	26.193円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年2月8日 至 2023年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	3,049,198,184円
受 取 利 息	3,048,939,403
そ の 他 収 益 金	1,381,243
支 払 利 息	△1,122,462
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△3,729,882,603
売 買 益	17,114,141,533
売 買 損	△20,844,024,136
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△183,323,303
取 引 益	100,997,773
取 引 損	△284,321,076
(D) そ の 他 費 用	△23,486,228
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△887,493,950
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	93,149,399,182
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,574,818,448
(H) 解 約 差 損 益 金	△9,481,205,179
(I) 計 (E+F+G+H)	93,355,518,501
次 期 繰 越 損 益 金(I)	93,355,518,501

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は56,972,115,875円、期中追加設定元本額は6,303,164,048円、期中一部解約元本額は5,624,911,607円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC外国債券インデックスファンドL	14,626,185,952円
インデックスコレクション (外国債券)	9,238,659,547円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	5,479,849,568円
私募外国債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	4,891,314,804円
インデックスコレクション (バランス株式30)	4,885,075,400円
外国債券バンプファンド私募A (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	2,979,343,710円
外国債券インデックスファンド	1,969,452,026円
DC外国債券インデックスファンド	1,900,402,136円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	1,406,851,739円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	1,170,380,456円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	1,153,818,507円
DCバランスファンド50	1,035,865,717円
外国債券インデックスe	1,033,375,043円
DCバランスファンド30	951,906,041円
インデックスコレクション (バランス株式50)	911,297,674円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	516,605,278円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	484,503,658円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	371,967,757円
外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	353,900,102円
インデックスコレクション (バランス株式70)	301,598,446円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	293,710,613円
DCバランスファンド70	236,829,006円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	232,593,690円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	200,749,064円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	177,600,348円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	171,173,388円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	168,369,489円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	101,962,174円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	81,229,025円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	76,446,573円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	75,236,652円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	62,414,556円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	53,837,287円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	43,950,779円
私募外国債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	11,912,111円

## お知らせ

該当事項はありません。